






Portafoglio: Cli ETF Easy NO Short

COMPOSIZIONE

Periodo di analisi: da 20/03/2008 a 16/12/2016

Strumento	Tipologia	Prezzo medio di carico	Prezzo attuale	Var. %	Quantità	Contro valore	Peso %
 Lyxor UCITS ETF MSCI All Country World	Etf e Etc	213,41	214,80	0,65%	33,00	7.088,40	27,16%
 iShares S&P 500 UCITS ETF Dis \$	Etf e Etc	19,11	21,54	12,68%	329,00	7.085,02	27,15%
 Lyxor UCITS ETF STOXX Europe 600 Indus.Goods&Serv.	Etf e Etc	50,25	52,23	3,95%	137,00	7.155,51	27,42%
 Lyxor UCITS ETF EuroMTS 3-5Y Investment Grade	Etf e Etc	151,32	153,16	1,22%	31,00	4.747,96	18,19%
 Liquidità						20,69	0,08%
Totale						26.097,57	

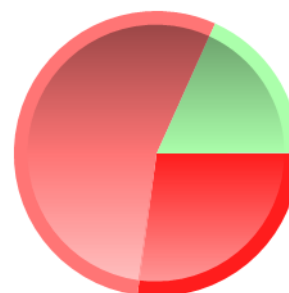
Tutti i valori sono espressi in EUR

PIANO CEDOLARE

Strumento	Cedole passate	Cedole previste
iShares MSCI World UCITS ETF Dis \$	469,80	0,00
iShares EURO STOXX 50 UCITS ETF Dis EUR	340,79	0,00
iShares S&P 500 UCITS ETF Dis \$	331,62	0,00
Totale	1142,22	0,00

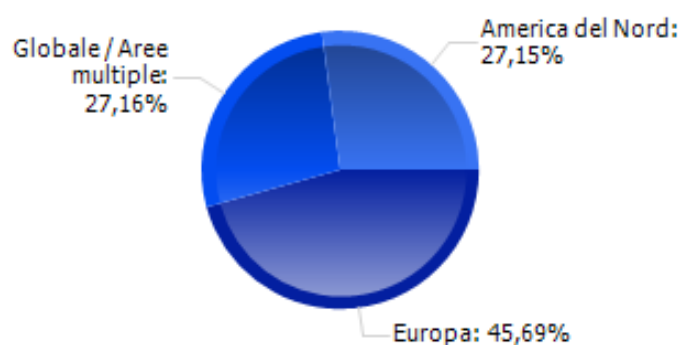
Composizione del portafoglio:

Caratteristiche	Volatilità	Peso %
■ Strumenti azionari ed assimilabili ad alta volatilità	oltre 20%	27,16%
■ Strumenti azionari ed assimilabili a media volatilità	fino a 20%	54,57%
■ Strumenti obbligazionari ed assimilabili a bassa volatilità	fino a 5%	18,19%
■ Liquidità e strumenti finanziari con volatilità minima	fino a 1%	0,08%



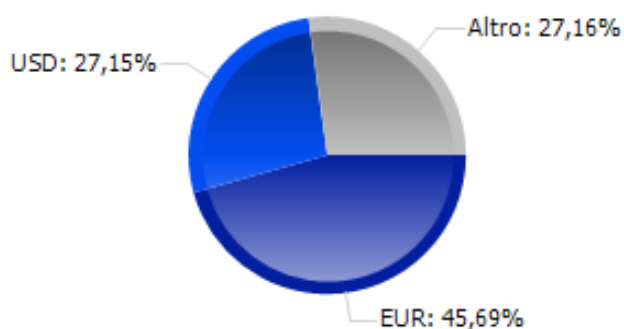
Esposizione geografica del portafoglio:

Esposizione geografica	Peso %
■ Europa	45,69%
■ Globale / Aree multiple	27,16%
■ America del Nord	27,15%



Esposizione valutaria del portafoglio:

Esposizione valutaria	Peso %
■ EUR	45,69%
■ USD	27,15%
■ Altro	27,16%



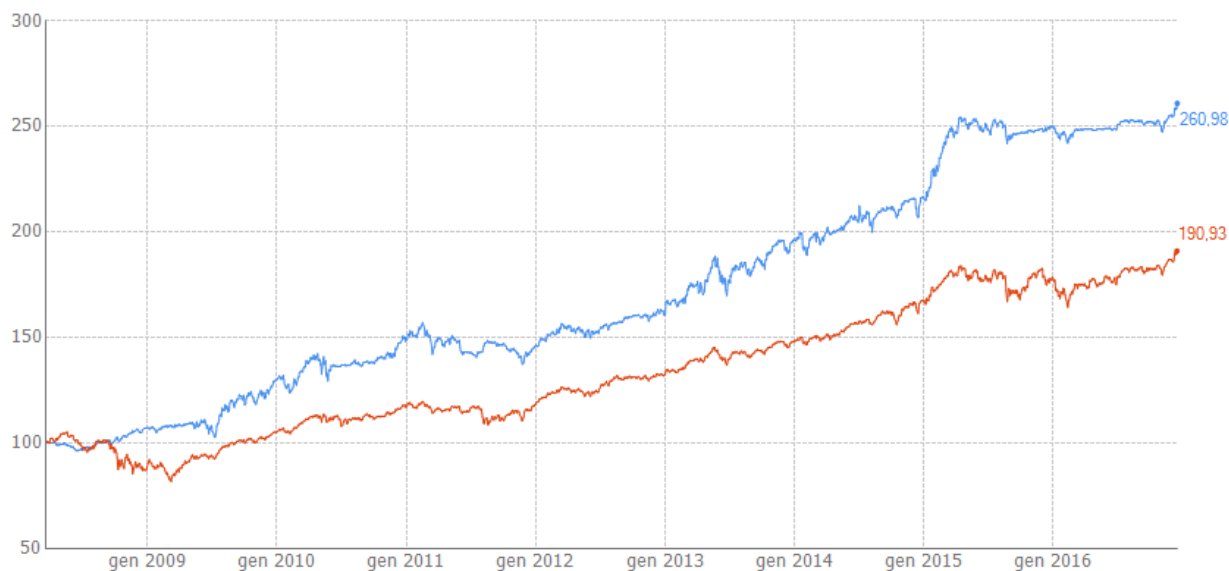
Evoluzione del portafoglio, periodo: 20/03/2008 - 16/12/2016



Patrimonio a inizio periodo: 10.000,00 EUR

Patrimonio a fine periodo: 26.097,57 EUR

Indice di portafoglio (TWRR, base 100), periodo: 20/03/2008 - 16/12/2016

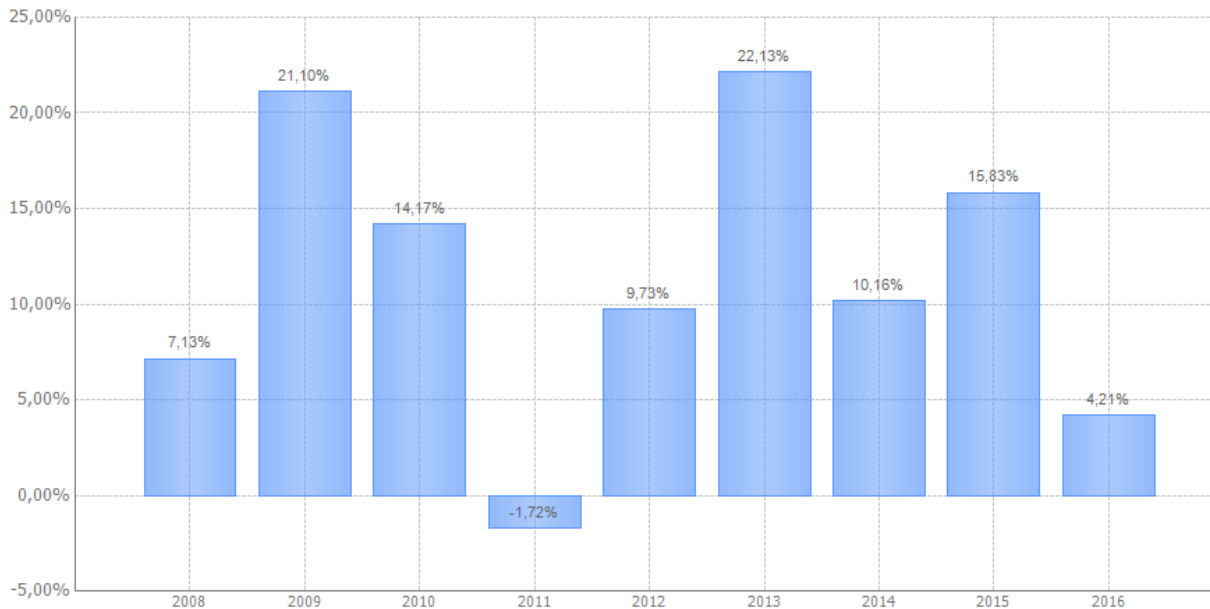


■ Cli ETF Easy NO Short

■ 50 ML EUR BROAD 3-5y+50MSCI WRL

ANALISI

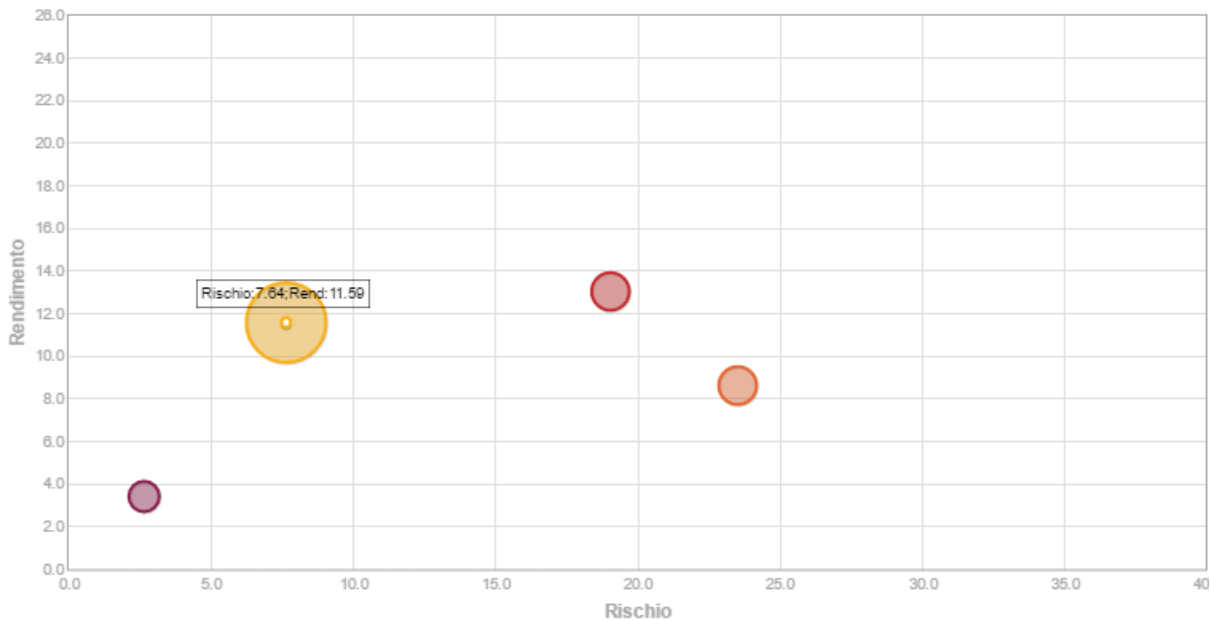
Rendimento annualizzato: 11,59%



Periodo	Rendimento	Volatilità	Volatilità negativa	Sharpe	Sortino	Draw Down
Da inizio anno	4,21%	3,29%	1,38%	1,45	3,45	3,33%
1 anno	4,79%	3,29%	1,38%	1,45	3,45	3,33%
3 anni	36,48%	5,82%	2,18%	1,64	4,37	5,91%
5 anni	82,13%	6,41%	2,64%	1,95	4,73	9,99%
10 anni		7,64%	3,60%	1,37	2,90	
Da inizio periodo	160,98%	7,64%	3,60%	1,37	2,90	12,62%

RISCHIO E RENDIMENTO

Periodo: da 20/03/2008 a 16/12/2016



Nome	Rendimento*	Rischio*
■ Cli ETF Easy NO Short	11,59 %	7,64 %
■ Lyxor UCITS ETF STOXX Europe 600 Indus.Goods&Serv.	8,63 %	23,50 %
■ Lyxor UCITS ETF MSCI All Country World	-	-
■ iShares S&P 500 UCITS ETF Dis \$	13,05 %	19,03 %
■ Lyxor UCITS ETF EuroMTS 3-5Y Investment Grade	3,42 %	2,65 %

* valori annualizzati